

# 運用報告書 (全体版)

第21期<決算日2022年6月10日>

## MHAMトピックスファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型	
信託期間	2001年6月29日から無期限です。	
運用方針	主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券に投資を行い、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に連動した投資成果を目指します。	
主要投資対象	MHAMトピックスファンド	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。
運用方法	株式と株価指数先物取引等の合計の組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。運用の効率化を図るため、ならびに追加設定・一部解約等に対応するため、株価指数先物取引等を利用することがあります。	
組入制限	MHAMトピックスファンド	株式への実質投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎期、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額の範囲とし、分配金額は、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。収益分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。	

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「MHAMトピックスファンド」は、2022年6月10日に第21期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

# MHAMトピックスファンド

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			東証株価指数 (TOPIX、 配当込み) (ベンチマーク)		株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 率	期 騰 落 率	期 騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
17期 (2018年6月11日)	14,292	240	13.9	13,973.33	12.3	94.3	4.8	1,486
18期 (2019年6月10日)	12,438	200	△11.6	12,144.20	△13.1	94.1	5.0	1,569
19期 (2020年6月10日)	13,036	220	6.6	12,705.45	4.6	95.8	3.8	1,710
20期 (2021年6月10日)	15,621	280	22.0	15,316.01	20.5	95.3	4.3	2,050
21期 (2022年6月10日)	15,525	260	1.0	15,573.27	1.7	97.2	2.8	2,329

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) ベンチマークは、設定日前営業日 (2001年6月28日) における値を10,000として指数化しています (以下同じ)。

(注4) ベンチマークは、2021年4月1日までは東証株価指数 (TOPIX)、2021年4月2日以降は東証株価指数 (TOPIX、配当込み) のデータを使用しています (以下同じ)。

(注5) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注6) 東証株価指数 (TOPIX) の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社 (以下「J P X」という) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有しています。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません (以下同じ)。

(注7) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		東証株価指数 (TOPIX、 配当込み) (ベンチマーク)		株式 組入比率	株式 先物比率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2021年6月10日	円	%		%	%	%
6月末	15,621	-	15,316.01	-	95.3	4.3
7月末	15,530	△0.6	15,230.65	△0.6	93.7	5.7
8月末	15,187	△2.8	14,898.84	△2.7	94.9	4.6
9月末	15,654	0.2	15,370.86	0.4	94.8	4.7
10月末	16,326	4.5	16,040.44	4.7	96.3	3.8
11月末	16,084	3.0	15,813.28	3.2	96.8	3.4
12月末	15,493	△0.8	15,242.80	△0.5	84.8	1.0
2022年1月末	16,023	2.6	15,768.64	3.0	97.1	3.4
2月末	15,241	△2.4	15,006.86	△2.0	95.8	4.2
3月末	15,167	△2.9	14,941.79	△2.4	98.0	1.3
4月末	15,810	1.2	15,584.03	1.7	96.9	3.1
5月末	15,425	△1.3	15,210.16	△0.7	96.2	3.9
5月末	15,536	△0.5	15,329.45	0.1	96.7	3.4
(期末) 2022年6月10日						
	15,785	1.0	15,573.27	1.7	97.2	2.8

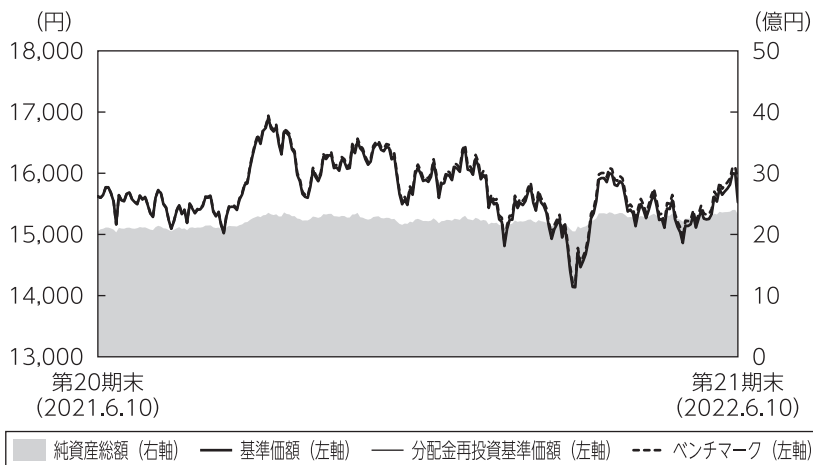
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■当期の運用経過 (2021年6月11日から2022年6月10日まで)

### 基準価額等の推移



第21期首： 15,621円  
第21期末： 15,525円  
(既払分配金260円)  
騰落率： 1.0%  
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

2021年9月には菅前首相の退陣表明を受けて上昇する場面もありましたが、期末にかけては新型コロナウイルスの新規感染者数の拡大、金融引き締めへの警戒感の高まりやロシアのウクライナ侵攻などを要因として下落しました。

## 投資環境

期初から2021年8月までは、新型コロナウイルスの感染状況や米国長期金利の動向などを要因として、一進一退の相場展開となりました。9月には、菅前首相の退陣表明を受けて上昇しました。10月以降は、中国恒大集団の信用リスク懸念や米国の金利上昇などを要因として反落しました。2022年1月から期末にかけては、新規感染者数の拡大、金融引き締めへの警戒感の高まりやロシアのウクライナ侵攻を受けて下落しました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

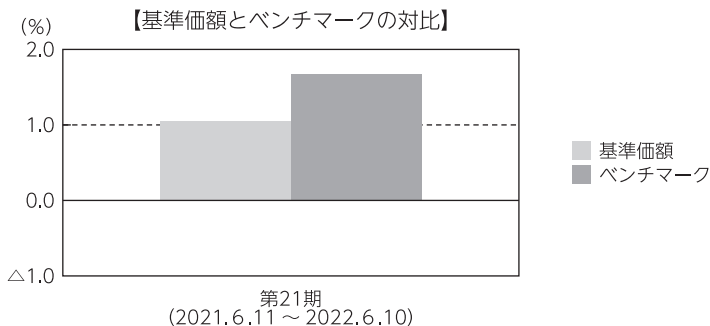
当ファンドの主要投資対象は、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドであり、マザーファンドの組入比率は期を通じて高位に維持するよう運用しました。

### ●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

ベンチマークであるTOPIX（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるTOPIX（配当込み）は前期末比で1.7%上昇しました。当ファンドはベンチマークを0.6%下回りました。この差異は、主に信託報酬によるものです。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

## 分配金

当期の収益分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、下記のとおりといたしました。なお、収益分配に充てなかった収益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2021年6月11日 ～2022年6月10日
当期分配金（税引前）	260円
対基準価額比率	1.65%
当期の収益	257円
当期の収益以外	2円
翌期繰越分配対象額	10,179円

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

## 今後の運用方針

### ●当ファンド

当ファンドの運用方針については、引き続き国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドを高位に組入れることにより、実質的な運用を当該マザーファンドにて行います。

### ●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドについては、引き続きベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

## ■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第21期		項目の概要
	(2021年6月11日 ～2022年6月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	103円	0.659%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は15,680円です。
(投信会社)	( 31)	(0.198)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	( 60)	(0.385)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	( 12)	(0.077)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	( 0)	(0.001)	
(先物・オプション)	( 0)	(0.001)	
(c) その他費用	0	0.002	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監査費用)	( 0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
合計	104	0.663	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

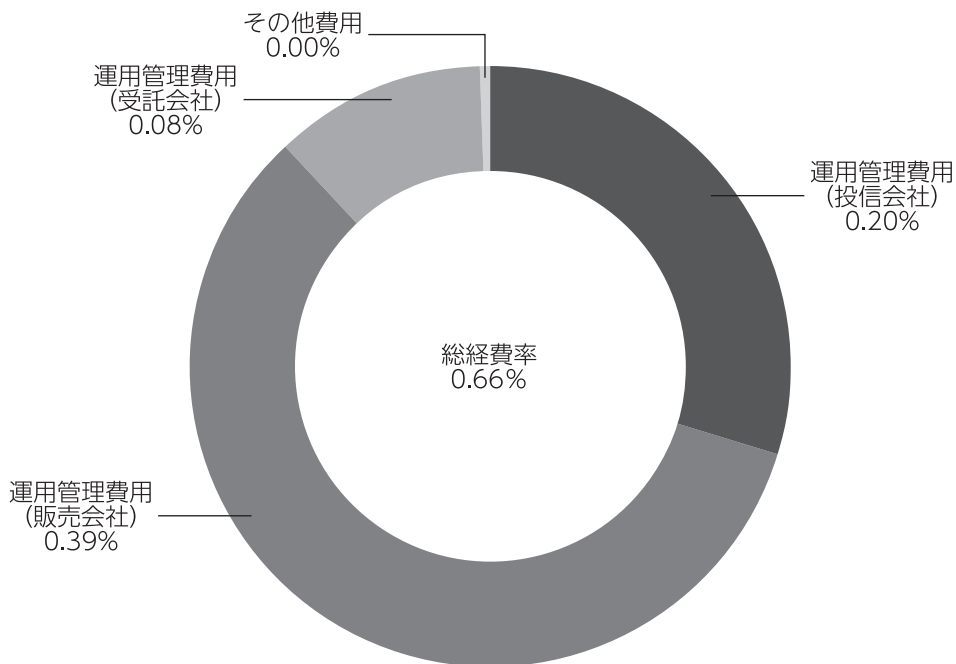
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## (参考情報)

### ◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.66%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

## ■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2021年6月11日から2022年6月10日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
MHAMトピックスマザーファンド	千□ -	千円 -	千□ 22,066	千円 52,067
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	205,742	664,482	115,279	379,216

## ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	1,072,027,514千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	384,621,641千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	2.78

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

## ■利害関係人との取引状況等（2021年6月11日から2022年6月10日まで）

### 【MHAMトピックスファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	40千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	1千円
(B) / (A)	4.9%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

### 【MHAMトピックスマザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。



【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
株 式	百万円 580,429	百万円 272,293	% 46.9	百万円 491,598	百万円 199,637	% 40.6

平均保有割合 0.5%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	百万円 4,354	百万円 3,815	百万円 3,014

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 1,221

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリソース、オリエントコーポレーションです。

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首(前 期 末)	当 期		末
	□ 数	□ 数	評 価 額	評 価 額
MHAMトピックスマザーファンド	千口 22,066	千口 -	千円 -	千円 -
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	624,054	714,517	2,328,756	2,328,756

■投資信託財産の構成

2022年6月10日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	千円 2,328,756	% 97.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	51,957	2.2
投 資 信 託 財 産 総 額	2,380,714	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年6月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,380,714,551円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	13,208,701
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額)	2,328,756,850
未 収 入 金	38,749,000
(B) 負 債	51,487,857
未 払 収 益 分 配 金	39,008,233
未 払 解 約 金	5,068,029
未 払 信 託 報 酬	7,394,190
そ の 他 未 払 費 用	17,405
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	2,329,226,694
元 本	1,500,316,688
次 期 繰 越 損 益 金	828,910,006
(D) 受 益 権 総 口 数	1,500,316,688口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	15,525円

(注) 期首における元本額は1,312,509,385円、当期中における追加設定元本額は535,427,210円、同解約元本額は347,619,907円です。

## ■損益の状況

当期 自2021年6月11日 至2022年6月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△786円
受 取 利 息	39
そ の 他 収 益 金	209
支 払 利 息	△1,034
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	36,599,088
売 買 益	50,528,866
売 買 損	△13,929,778
(C) 信 託 報 酬 等	△14,700,444
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	21,897,858
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	290,043,013
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	555,977,368
(配 当 等 相 当 額)	(1,236,283,876)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△680,306,508)
(G) 合 計 (D + E + F)	867,918,239
(H) 収 益 分 配 金	△39,008,233
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	828,910,006
追 加 信 託 差 損 益 金	555,977,368
(配 当 等 相 当 額)	(1,237,679,925)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△681,702,557)
分 配 準 備 積 立 金	289,616,695
繰 越 損 益 金	△16,684,057

- (注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。  
(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。  
(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。  
(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	38,581,915円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	1,237,679,925
(d) 分 配 準 備 積 立 金	290,043,013
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	1,566,304,853
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	10,439.83
(g) 分 配 金	39,008,233
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	260

## ■分配金のお知らせ

**1万口当たり分配金 260円**

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。  
※受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

### 分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

## 《お知らせ》

### 約款変更のお知らせ

■主要投資対象から「MHAMトピックスマザーファンド」を削除しました。

(2021年9月17日)

■当ファンドが投資対象とする「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」において信託金の限度額を1兆円から3兆円に変更しました。

(2022年3月15日)

■当ファンドが投資対象とする「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」において、東京証券取引所の市場区分の再編に伴い、主要投資対象を「東京証券取引所第1部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄」に変更しました。

(2022年4月4日)

# 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 運用報告書

第20期（決算日 2022年2月7日）

（計算期間 2021年2月9日～2022年2月7日）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年10月30日から無期限です。
運用方針	主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰落	中率	(配当込み) ベンチマーク	期騰落 中率			
16期 (2018年2月7日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
17期 (2019年2月7日)	26,432	17.8	2,547.46	17.9	98.1	0.8	289,238
18期 (2020年2月7日)	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	279,184
19期 (2021年2月8日)	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760
20期 (2022年2月7日)	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3	318,586
	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5	397,336

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（㈩東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は、㈩東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈩東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、㈩東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

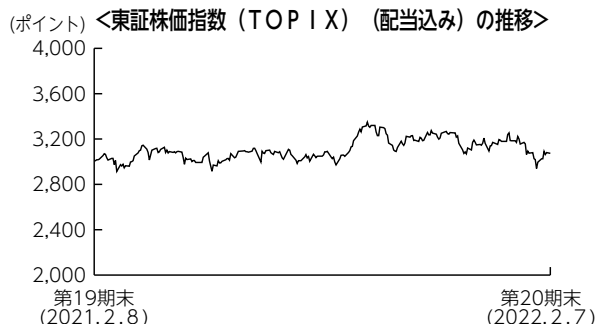
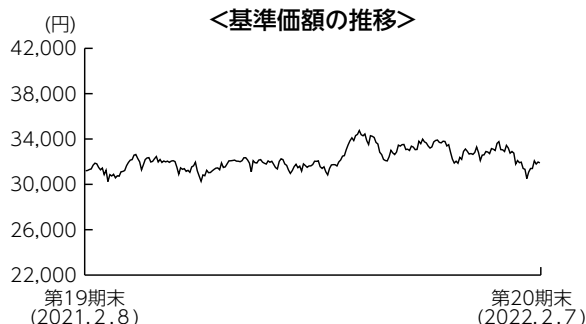
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX) (配当込み) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021年 2月 8日	円 31,202	% -	ポイント 3,006.47	% -	% 97.7	% 2.3
2 月 末	30,248	△3.1	2,914.58	△3.1	99.0	1.1
3 月 末	31,972	2.5	3,080.87	2.5	96.2	4.0
4 月 末	31,068	△0.4	2,993.46	△0.4	96.5	3.5
5 月 末	31,493	0.9	3,034.76	0.9	96.6	3.4
6 月 末	31,864	2.1	3,070.81	2.1	96.0	4.0
7 月 末	31,172	△0.1	3,003.91	△0.1	97.2	2.8
8 月 末	32,156	3.1	3,099.08	3.1	97.1	2.9
9 月 末	33,562	7.6	3,234.08	7.6	96.3	3.8
10 月 末	33,082	6.0	3,188.28	6.0	96.8	3.4
11 月 末	31,886	2.2	3,073.26	2.2	84.8	1.0
12 月 末	32,994	5.7	3,179.28	5.7	97.1	3.4
2022年 1 月 末	31,401	0.6	3,025.69	0.6	95.8	4.2
(期 末) 2022年 2月 7日	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2021年2月9日から2022年2月7日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は31,896円となり、前期末比で2.2%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

2021年9月には菅前首相の自民党総裁選への不出馬表明を受けて、新たな政策への期待の高まりから基準価額は上昇しました。その後は、中国不動産開発大手の中国恒大集団の信用リスク懸念、米国での金融引き締めによる金利上昇への警戒感の高まり、世界的な新型コロナウイルスの感染拡大等を要因として基準価額は下落しました。

### 投資環境

期初から2021年8月までは、国内の感染状況や米国長期金利の動向などを要因として、一進一退の相場展開となりました。9月には、菅前首相の退陣表明を受けて上昇しました。その後、中国恒大集団の信用リスク懸念や米国の金利上昇などを要因として反落しました。その後も、新型コロナウイルスの感染拡大懸念や金融引き締めへの警戒感の高まりなどを受けて下落する場面もありましたが、期末にかけては好決算銘柄を中心に反発しました。

### ポートフォリオについて

ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

**【運用状況】** (注1) 組入比率は純資産総額に対する割合です。  
(注2) 業種は東証33業種分類によるものです。

○組入上位10業種  
期首 (前期末)

No.	業種	比率
1	電気機器	17.6%
2	情報・通信業	9.2
3	化学	7.3
4	輸送用機器	6.9
5	医薬品	5.6
6	機械	5.6
7	サービス業	5.5
8	銀行業	4.6
9	小売業	4.6
10	卸売業	4.4



期末

No.	業種	比率
1	電気機器	17.5%
2	輸送用機器	8.5
3	情報・通信業	7.8
4	化学	6.4
5	サービス業	5.7
6	卸売業	5.5
7	銀行業	5.4
8	機械	5.1
9	医薬品	4.7
10	小売業	4.1

○組入上位10銘柄  
期首 (前期末)

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.0%
2	ソニー	日本・円	2.8
3	ソフトバンクグループ	日本・円	2.7
4	キーエンス	日本・円	2.1
5	任天堂	日本・円	1.3
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.3
7	日本電産	日本・円	1.3
8	リクルートホールディングス	日本・円	1.3
9	信越化学工業	日本・円	1.2
10	日本電信電話	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,183銘柄	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	4.3%
2	ソニーグループ	日本・円	2.9
3	キーエンス	日本・円	2.0
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.7
5	リクルートホールディングス	日本・円	1.5
6	東京エレクトロン	日本・円	1.3
7	日本電信電話	日本・円	1.3
8	任天堂	日本・円	1.2
9	信越化学工業	日本・円	1.2
10	ソフトバンクグループ	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,174銘柄	

**ベンチマークとの差異について**

ベンチマークは前期末比で2.2%上昇しました。

当ファンドはベンチマークと同等のリターンとなりました。ポートフォリオのリスク特性をベンチマークにほぼ一致させたため、ベンチマーク沿ったパフォーマンスとなりました。

**今後の運用方針**

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション)	1円 (0) (0)	0.002% (0.001) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
合 計	1	0.002	
期中の平均基準価額は32,238円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## ■ 売買及び取引の状況 (2021年2月9日から2022年2月7日まで)

### (1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内 上 場		千株	千円	千株	千円
		192,672.8 (6,584.913)	479,219,336 (-)	161,731.513	395,856,402

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ( ) 内は、株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

### (2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株式先物取引	百万円 144,564	百万円 142,625	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

## ■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	875,075,739千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	369,108,651千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	2.37

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。



## ■利害関係人との取引状況等（2021年2月9日から2022年2月7日まで）

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 479,219	百万円 130,245	% 27.2	百万円 395,856	百万円 59,442	% 15.0

### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 3,678	百万円 3,163	百万円 3,133

### (3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 1,300

### (4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	7,278千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	148千円
(B) / (A)	2.0%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

# ■組入資産の明細

## (1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額	
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
極洋	5.4	7.2	22,224				矢作建設工業	16.7	20.5	15,641	DM三井製糖ホールディングス	9.5	13.7	27,578							
日本水産	148.6	199.7	103,844				ビーエス三菱	12.2	15.4	9,548	塩水海精糖	14.4	19.9	4,258							
マルハニチロ	25.2	31.4	78,468				日本ハウスホールディングス	25.6	31.7	14,360	日新製糖	4.5	7.6	13,148							
雪国まいたけ	9.9	14.8	17,863				大東建託	40.5	47.2	636,256	森永製菓	27.8	34.8	128,412							
カネコ種苗	4.6	4.9	7,408				新日本建設	15.9	19.9	15,004	中村屋	2.5	2.6	8,710							
サカタのタネ	19.2	24	78,600				N I P P O	30.8	—	—	江崎グリコ	32.7	40.7	153,846							
ホクト	13.6	17	33,320				東亜道路工業	2.4	2.6	13,052	名糖産業	5.6	6.9	11,460							
ホクリヨウ	2.3	3.4	2,363				日本道路	3.6	4.6	38,180	井村屋グループ	6.8	8.6	19,169							
<b>鉱業 (0.3%)</b>							東亜建設工業	9.9	11.5	27,933	不二家	7.6	8.5	19,371							
住石ホールディングス	27.8	35.1	4,773				日本国土開発	36.3	45.5	24,115	山崎製パン	89	110.7	179,887							
日鉄鉱業	3.7	4.6	28,474				若築建設	6.7	7.7	13,213	第一屋製パン	2.9	3.5	1,858							
三井松島ホールディングス	6.7	8.3	12,640				東洋建設	41.6	51.7	29,882	モロゾフ	1.7	3.7	10,175							
I N P E X	590.1	800.9	940,256				五洋建設	157.5	182.7	116,745	寿スピリッツ	11.4	14.3	78,364							
石油資源開発	21	23.5	66,951				世紀東急工業	17.9	22.4	18,256	カルビー	54.1	67.3	164,817							
K&Oエナジーグループ	7.7	9.9	15,246				福田組	4.3	5	21,950	森永乳業	21.9	27.4	149,604							
<b>建設業 (2.3%)</b>							住友林業	87.2	118	240,602	六甲バター	8	11	16,280							
ヒノキヤグループ	4	4.5	9,292				日本基礎技術	11.7	12.7	7,975	ヤグルト本社	81.6	109.4	633,422							
ショーボンドホールディングス	22.9	28.5	143,925				巴コーポレーション	16.8	20.7	10,060	明治ホールディングス	78.5	97.6	704,676							
ミライト・ホールディングス	55.7	64.4	121,265				大和ハウス工業	342.4	425.6	1,442,358	雪印メグミルク	28.6	35.6	73,407							
タマホーム	9.7	12.1	29,717				ライト工業	21.3	29	53,679	プリマハム	16.8	18.6	44,807							
サンヨーホームズ	2.2	2.5	1,827				積水ハウス	402.2	500	1,164,500	日本ハム	45.4	56.5	237,865							
日本アーク	6.4	8.1	5,070				日特建設	9.9	9.8	6,997	林兼産業	3.6	3.8	1,919							
ファーストコーポレーション	4.9	6.4	4,454				北陸電気工事	6.6	9.8	8,065	丸大食品	11.8	14.8	22,555							
ベステラ	3	4	5,024				ユアテック	21.3	26.5	18,470	S Foods	10.7	13.3	43,424							
Robot Home	29.9	33.3	7,425				日本リーテック	7.7	9.6	13,468	柿安本店	4.1	5.2	13,577							
キャンディル	2.8	3.8	1,862				四電工	1.7	5.2	8,361	伊藤ハム&ポークホールディングス	76.7	95.7	64,310							
スペースリョーホールディングス	19.6	—	—				中電工	17.1	21.3	45,219	サッポロホールディングス	40.5	50.4	112,644							
ダイセキ環境ソリューション	3.1	3.9	4,555				関電工	60.4	75.2	65,424	アサヒグループホールディングス	259.3	347.2	1,656,144							
第一カッター興業	4	5.1	7,063				きんでん	80.2	103.1	166,506	キリホールディングス	503.3	542.4	1,020,796							
安藤・間	102.9	99.1	86,514				東京エネシス	12.3	15.5	15,035	宝ホールディングス	87.9	100.4	111,845							
東急建設	47	58.5	40,131				トーエネック	3.8	4.7	15,110	オノンホールディングス	34.2	43	14,534							
コムシスホールディングス	56.9	64.4	175,683				住友電設	10.5	11.5	25,587	養命酒製造	4	5.1	8,981							
ビーアールホールディングス	19	27.1	9,674				日本電設工業	20.4	25.4	37,134	コトヨシホチヤグループホールディングス	90.8	103.7	141,757							
福臨コンストラクショングループ	10.1	12.6	25,263				エクシオグループ	56.2	69.8	162,424	サントリー食品インターナショナル	79.5	98.7	443,163							
東建コーポレーション	4.9	5.5	50,655				新日本空調	9.8	12.2	24,790	ダイドールグループホールディングス	6.7	7.7	37,345							
ソネック	1.7	2.3	2,366				九電工	26.1	35.6	109,470	伊藤園	36.1	45	279,900							
ヤマウラ	7.2	10.3	10,186				三機工業	26.3	30.2	42,823	キーコーヒー	11.8	14.8	30,532							
オリエンタル白石	—	67.8	16,339				日揮ホールディングス	123.6	141.9	160,914	ユニカフェ	3.9	5	4,790							
大成建設	115.4	133.2	508,158				中外炉工業	4.1	4.7	7,562	ジャパンフーズ	1.5	1.7	2,050							
大林組	370.8	460.9	434,167				ヤマト	11.9	13.8	9,784	日清オйлリグループ	15.3	18.7	56,287							
清水建設	347.3	431.8	338,099				太平電業	8.2	10.4	28,797	不二製油グループ本社	29	32	74,560							
飛鳥建設	10.5	12.3	13,161				高砂熱学工業	33.5	41.7	79,104	かどや製油	1	1.1	4,411							
長谷工コーポレーション	121.3	137.3	200,183				三晃金属工業	1.6	1.7	4,236	Jーオイルミルズ	5.6	14.2	24,026							
松井建設	14.7	18.4	13,082				朝日工業社	2.1	3.3	9,543	キッコーマン	85.4	106.3	932,251							
鹿高組	1.2	1.7	6,834				明星工業	24.1	29.9	20,989	味の素	282.3	325.9	1,055,590							
鹿島建設	271.6	337.9	465,964				大気社	18	22.6	63,777	ブルドックソース	—	6.4	12,524							
不動テトラ	9.1	9.8	15,278				ダイダイン	8.2	10.3	23,257	キュービー	66	77.6	186,007							
大東建設	4.9	5	6,680				日比谷総合設備	12.2	14.9	28,161	ハウス食品グループ本社	44.4	55.3	161,531							
鉄建建設	7.5	10.3	18,797				フィル・カンパニー	2.1	2.8	3,166	カゴメ	48.5	56	161,840							
西松建設	26.5	28	104,580				テスホールディングス	—	8.5	11,313	焼津水産化学工業	4.8	5.1	4,625							
三井住友建設	89.4	103.8	44,426				インフロエア・ホールディングス	—	196.5	207,111	アリアケジャパン	10.9	13.5	77,625							
大豊建設	8.1	6.8	25,092				OS J Bホールディングス	54.1	—	—	ビエトロ	1.2	1.2	2,152							
前田建設工業	92.9	—	—				東洋エンジニアリング	15.4	19.4	12,959	エバラ食品工業	2.4	2.5	7,075							
佐田建設	6.7	10.2	4,773				レイズネクスト	20	22.6	25,515	やまみ	1.1	1.7	3,010							
ナカノフード建設	9.7	10.9	3,738				<b>食料品 (3.4%)</b>				ニチレイ	56.5	67.3	176,056							
奥村組	20.4	27.1	86,584				ニッポン	35	43.5	72,949	東洋水産	61	71	342,220							
東鉄工業	16	21.5	52,481				日清製粉グループ本社	134.1	167	273,212	イートランドホールディングス	4.2	5.7	13,110							
イチケン	2.7	3.5	6,594				日東富士製粉	0.6	1.6	6,392	大冷	1.5	2	3,816							
富士ビー・エス	5	5.9	2,891				昭和産業	10.1	14.3	38,181	ソシム・フード・ホールディングス	6.7	7.9	4,005							
浅沼組	4.4	5.2	28,132				昭越製粉	10.8	13.7	8,863	日清食品ホールディングス	46.5	57.9	518,784							
戸田建設	154.1	191.4	142,401				中部飼料	14.6	16.7	16,983	永谷園ホールディングス	6	6.9	13,461							
熊谷組	17.1	23.5	69,842				フィード・ワン	16.2	20.2	14,503	一正蒲鉾	4	6.2	4,811							
北野建設	1.9	2.9	6,194				東洋精糖	1.7	1.8	1,845	フジッコ	13	13.8	26,896							
榎木組	1.6	4.1	6,076				日本甜菜製糖	6.4	8.1	13,737	ロック・フィールド	12.8	16	24,704							

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																								
	株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株	株	数	千株																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																			
日本たばこ産業	636.5	791.4	1,851,876	共和レザー	6.8	9.2	6,127	トリケミカル研究所	9.8	14.9	44,342	ケンコーマヨネーズ	7.3	8.5	11,517	昭和電工	87.9	124.8	297,398	ADEKA	53.3	66.3	167,473	くわばや日洋ホールディングス	7.8	9.6	18,240	住友化学	911.2	1,057.7	619,812	日油	43.6	49.2	252,888	なとり	6.9	8.1	16,200	住友精化	5.7	6.4	21,184	新日本理化学	19	23.6	5,923	イフジ産業	2.3	2.5	2,350	日産化学	63.9	78.4	516,656	ハリマ化成グループ	8.7	11	8,987	ビッルスコーポレーション	2.8	7.2	11,419	ラサ工業	3.8	5	8,095	花王	283.1	325.3	1,709,126	ファーマフーズ	-	14	22,848	クレハ	9.9	11.5	103,960	第一工業製薬	3.9	5.4	15,660	ユーグレナ	51.2	75	54,750	多木化学	4.5	5.6	29,400	石原ケミカル	3	7.5	9,915	紀文食品	-	8.6	8,187	テイカ	8.4	10.8	14,850	日華化学	4.3	5	4,015	ミヨシ油脂	4.4	6.2	6,869	石原産業	20.6	23.8	27,631	ニイタカ	2.4	3	6,849	理研ビタミン	11.2	15.4	26,257	片倉コープアグリ	2.4	2.5	2,875	三洋化成工業	6.9	8.6	44,118	織維製品 (0.5%)	片倉工業	15.6	13.8	33,992	東ソー	178.9	207.7	396,083	有機合成薬品工業	9.2	10.3	2,811	片倉ゼン	8.5	9.6	37,008	トクヤマ	34.3	46	90,666	大日本塗料	13.2	17.8	14,453	東洋紡	45.8	56.9	74,254	セントラル硝子	22	23.5	49,514	日本ペイントホールディングス	95.5	541.2	459,478	ユニチカ	33.8	39.2	11,956	東亜合成	70.7	80.1	90,352	関西ペイント	130.1	149.3	342,792	富士紡ホールディングス	5.6	6.4	24,288	大阪ソーダ	11.9	13.5	40,567	神東塗料	9.3	10	1,540	倉敷紡績	10.7	12.3	23,579	関東電化工業	27.3	31.6	34,033	中国塗料	27.9	34	30,668	シキボウ	6.6	7.9	7,244	デンカ	42.2	52.4	190,474	日本特殊塗料	8.7	10.9	9,156	日本毛織	38.1	43.4	38,929	信越化学工業	214.1	247.4	4,693,178	藤倉化成	16	18.3	8,820	ダイトウボウ	19.3	23.8	2,118	日本カーバイド工業	4.2	5.2	7,082	太陽ホールディングス	8.5	21.2	68,158	トア紡コーポレーション	4.1	4.3	1,754	堺化学工業	8.1	10	20,310	DIC	48.9	60.9	182,517	ダイドーミテッド	16.6	20.5	2,870	第一稀元素化学工業	11.7	13.4	15,276	サカタククス	25.3	28.7	28,183	帝国繊維	13	16.3	32,811	エア・ウォーター	118.1	136.2	238,350	東洋インキS Cホールディングス	94.5	30.5	58,712	帯人	109	135.4	187,393	日本薬品ホールディングス	95.3	138.5	316,195	T&K TOKA	24	31	10,120	東レ	838.4	1,042.5	699,309	日本化学工業	3.2	4.6	12,134	富士フィルムホールディングス	207.8	258.5	1,967,702	サカイオーベックス	3.1	-	-	資生堂	235	273.9	1,642,578	住江織物	2.1	3.4	6,504	東邦アセチレン	1.9	2.6	3,302	ライオン	153.7	177.6	268,708	日本フェルト	5.5	5.9	2,643	日本パーカライジング	58.4	72.6	74,632	高砂香料工業	7.4	10.3	28,953	イチカワ	1.3	1.4	1,937	高圧ガス工業	18.5	23.1	17,278	マンダム	24.7	30.9	39,644	日東製網	1.3	1.7	2,459	チタン工業	1.5	1.7	2,774	ミルボン	15.8	18.3	99,735	アツギ	9.3	11.5	6,704	四国化成工業	15.5	19	26,600	ファンケル	43	59.6	185,356	ダイニック	3.6	3.8	2,728	戸田工業	2.4	3.2	9,968	コーセー	22.2	27.7	304,146	セーレン	28.5	29.6	61,952	ステラ ケミファ	6.3	7.2	17,978	コタ	7	9.4	14,720	ソト	4	6.2	5,139	保土谷化学工業	3.4	4.6	24,012	シーボン	1.3	1.4	2,525	東海染工	1.3	1.4	1,605	日本触媒	21	24.2	144,716	ポレラ・オルビスホールディングス	50.5	62.8	108,895	小松マテール	19.1	23.6	29,877	大日精化工業	9.6	12	27,108	ノビアホールディングス	10	12.6	63,252	ワコールホールディングス	28.9	35.9	73,738	カナカ	30	37.3	145,843	アジパルホールディングス	3	3.5	3,846	ホギメディカル	15.6	19.5	61,425	三菱瓦斯化学	116	133.8	285,529	新日本製薬	2.4	4	5,300	クラウディアホールディングス	2.4	2.5	590	三井化学	100	130.8	397,632	エステー	7.7	9.5	14,601	T S Iホールディングス	34.7	47.9	15,807	J S R	116.2	134.4	463,680	アグロ カネシヨウ	4.5	5	6,515	マツカコーポレーション	3.7	4.6	5,409	東京応化工業	19.9	23.3	147,955	コニシ	19.5	24.1	38,222	ワールド	15.1	18.9	22,264	大阪有機化学工業	10.7	12.2	36,429	長谷川香料	20.5	25.5	61,786	三陽商会	6	6.9	5,954	三菱ケミカルホールディングス	774.1	962.6	807,910	星光PMC	6.9	8.6	5,633	ナイガイ	3.8	4.1	1,160	K Hネオケム	19.1	23.7	72,640	小林製薬	33.1	41.3	391,111	オンワードホールディングス	69.3	86.3	25,631	ダイセル	155.5	207.2	181,507	荒川化学工業	9.9	12.3	13,849	ルックホールディングス	4	4.6	6,076	住友ベークライト	18.2	22.8	121,752	メック	8.1	11	33,880	キムラタン	68.3	79.9	1,518	積水化学工業	244.9	301.3	583,618	日本高純度化学	3.3	4.1	10,569	ゴールドウイン	19.1	26	158,340	日本ゼオン	104.5	129.8	175,489	タカラバイオ	31	38.5	88,280	デサント	19.8	28.1	97,085	アイカ工業	32.2	40.1	127,317	JCU	13.3	16.6	75,613	キング	4.6	6.7	3,463	宇部興産	58.4	67.8	147,058	新田セラチン	7.7	9.3	6,045	ヤマインターナショナル	10.6	13.3	3,790	積水樹脂	19.1	21.9	43,843	OA Tアグリオ	2.3	3.2	6,425	パルプ・紙 (0.2%)	王子ホールディングス	521.3	602.3	363,789	タキロンシーアイ	25.2	31.4	17,552	デクセラアルズ	33	38.2	118,420	日本製紙	51.1	69	81,213	旭有機材	6.6	8.1	17,528	アース製薬	8.9	12.1	71,027	三菱製紙	17.1	21.3	6,794	ニチバン	6.2	8.6	14,852	北興化学工業	10.9	13.8	10,874	北越コーポレーション	82.9	94.7	74,244	リケンテクノス	28.2	35.4	16,142	大成ラミック	3.7	4.6	12,962	中越パルプ工業	4.7	5.6	5,538	大倉工業	5.5	7.5	15,037	クミアイ化学工業	48.8	54.8	44,223	巴川製紙所	3.7	4.6	3,762	積水化成工業	15.6	19.6	8,800	日本農業	21.2	26.4	14,018	大王製紙	56	69.6	133,284	群栄化学工業	2.2	3.5	12,075	アキレス	8.2	9.4	11,637	阿波製紙	3	4	1,324	タイガースポリマー	6.7	8.5	3,714	有沢製作所	16.5	21.5	21,414	レンゴ	119.4	136.3	117,763	ミライアル	3.7	4.7	6,974	日東電工	75.7	89	775,190	トーモク	7.2	9	15,849	ダイキアクシス	4.3	5.6	3,925	レック	14	19.1	18,106	ザ・パック	8.7	11	29,931	ダイキョーニシカワ	24.5	30.7	18,696	三光合成	12.4	15.5	5,766	化学 (6.6%)	北の達人コーポレーション	41.4	51.4	11,205	竹本容器	4.2	5.3	4,202	きもと	18.9	22.9	4,854	クラレ	182.3	210.4	217,764	森六ホールディングス	6.3	7.9	15,634	藤森工業	10.6	13.2	54,978	旭化成	767.5	954.1	1,064,775	恵和	1.7	3.6	18,504	前澤成工業	7.8	9.5	11,789	来未工業	4.3	5.5	8,475	扶桑化学工業	9.1	12.9	61,081	ウェーブリンクホールディングス	4	5.6	3,931	エフピコ	21.8	27	91,125

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		銘柄	期首(前期末)	当 期 末		銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
天馬	8.9	11.6	30,206	バンドー化学	20.9	24	21,216	日本軽金属ホールディングス	31.9	36.7	65,582
信越ポリマー	18.2	26.4	29,409	ガス・土産 (0.8%)				三井金属鉱業	31.6	39.4	128,444
東リ	31.1	38.8	8,691	日東紡績	17.5	22	64,658	東邦亜鉛	6.5	8.1	19,658
ニフコ	43.4	49.1	168,413	A G C	108.6	135.1	680,904	三菱マテリアル	77.2	95.9	199,951
バルカー	9.7	12	30,336	日本板硝子	59.8	70.5	32,853	住友金属鉱山	149.4	185.8	998,303
ユニ・チャーム	250.8	283.4	1,248,377	石塚硝子	2.1	2.5	5,107	DOWAホールディングス	29.6	39.7	205,646
ジョーエコーポレーション	2.6	4	2,648	日本山村硝子	5.3	5.7	4,474	古河機械金属	10.3	24.1	30,438
<b>医薬品 (4.9%)</b>				日本電気硝子	43.8	59.1	166,130	エス・サイエンス	54.7	69	1,587
協和キリン	119	172.7	504,802	オハラ	4.7	5.9	6,549	大塚チタニウムテクノロジーズ	12	16.7	14,345
武田薬品工業	983.7	1,155.5	3,978,386	住友大阪セメント	21.3	27.3	96,505	東邦チタニウム	20.9	26.2	23,946
アステラス製薬	1,025.1	1,274.7	2,576,806	太平洋セメント	70	83.5	192,634	UACJ	17.7	22.2	51,415
大日本住友製薬	87.6	90.9	112,897	日本ヒューム	11	15.4	10,641	C K サンエツ	2.1	3.2	12,848
塩野義製薬	148.7	184.8	1,475,443	日本コンクリート工業	25.4	29.1	8,235	古河電気工業	36.4	45.2	99,666
わかもと製薬	14.3	17.6	5,332	三谷セキサン	5.5	6.9	44,988	住友電気工業	407.9	543.6	848,559
あすか製薬	13.4	-	-	アジアビルホールディングス	18.5	23.3	10,298	フジクラ	141.1	162	100,440
日本新薬	33.5	38.5	294,140	東海カーボン	115.5	123.2	141,310	昭和電線ホールディングス	11.3	12.6	23,927
ビオフェルミン製薬	2.2	-	-	日本カーボン	6.5	7.6	30,324	東京特殊電線	1.5	1.7	4,921
中外製薬	369.8	460	1,867,140	東洋炭素	7	9.5	27,559	タツタ電線	20.6	25.7	11,590
科研製薬	20.2	23.1	94,825	ハタカカンパニ-リミテド	6.6	8.2	36,982	カネレ電気	2.2	2.8	4,253
エーザイ	130.6	176.1	1,012,927	TOTO	84.5	105	512,925	平河ビューテック	6.5	8.2	9,585
ロート製薬	56.3	75.5	241,977	日本碍子	130	159.3	296,616	リョービ	14.2	17.9	20,083
小野薬品工業	271.5	337.6	955,576	日本特殊陶業	90	111.9	246,739	アーレスティ	14.6	15.4	5,836
久光製薬	34.4	38.8	142,784	ダント-ホールディングス	8.6	9.5	3,344	アサヒホールディングス	21.9	58.3	128,376
持田製薬	16.4	18.7	69,564	MARUWA	4.1	5.1	70,482	<b>金属製品 (0.6%)</b>			
参天製薬	205.7	274.1	362,086	黒川フラクトリーブーズ	2.8	3.5	13,772	稲葉製作所	6.7	8.3	10,665
扶桑薬品工業	3.8	5.2	11,679	高崎橋磨	2	2.7	11,947	宮地エフエフグループ	3.8	4.6	14,628
日本ケミファ	1.2	1.2	2,547	ヨータイ	8.6	9.4	12,097	トーカロ	30.2	37.6	49,632
ツムラ	39.5	45.7	153,552	イソライト工業	5.3	6.6	7,906	アルファ	4.5	4.8	5,294
日医工	33.4	45.6	34,063	東京薬業	15.7	19.4	5,975	SUMCO	149.6	223.9	444,217
キッセイ薬品工業	20.9	26.2	61,805	ニッカト-	5.4	6.8	4,168	川田テクノロジーズ	2.4	3	11,910
生化学工業	20.9	26	24,700	フジミコンコーポレテッド	9.5	11.9	79,135	R5 Technologies	3.8	4.7	26,555
栄研化学	20.8	25.9	46,309	グロニネ工業	3.8	4.9	4,914	ジェイテックホールディングス	1	1.6	2,529
白水製薬	4.6	5.9	5,823	エ-アンドエ-マテリアル	2.4	3.2	2,880	信和	6.4	9.1	7,543
鳥居薬品	7.4	8	25,120	ニチス	29.9	34.2	88,749	東洋グループホールディングス	74.5	92.6	140,659
JCRファーマ	33.3	41.5	84,328	ニチハ	16.5	20.5	53,669	ホッカンホールディングス	6	8.2	11,627
東和薬品	17.1	21.1	61,823	<b>鉄鋼 (0.8%)</b>				コロナ	6.8	8.6	7,731
富士製薬工業	8.1	9.1	10,090	日本製鉄	558.1	650.6	1,279,730	楯岡フジヨ-ホールディングス	20.1	25	51,000
沢井製薬	25.9	-	-	神戸製鋼所	213.7	271.2	154,312	駒井ハルテック	2.4	2.9	6,878
ゼリア新薬工業	21.5	26.9	51,325	中山製鋼所	17.1	23.1	10,418	高田機工	0.8	0.7	1,989
第一三共	1,015	1,155.4	2,727,321	合同製鐵	6.3	7.9	10,657	三和ホールディングス	110.2	137.1	164,794
キョ-リン製薬ホールディングス	26.1	29.6	54,967	ジェイエフイーホールディングス	338.2	392.6	602,641	文化シヤッター	34.6	46.4	47,699
大幸薬品	14.5	22.3	14,338	東京製鐵	45.6	49.6	56,891	三協立山	15	18.9	11,623
ダイト	7.5	9.4	26,479	共英製鋼	13.1	16.5	25,789	アルインコ	7.8	10.9	9,919
大塚ホールディングス	245.8	305.5	1,249,800	大和工業	24.9	28	104,160	東洋シヤッター	2.4	2.5	1,357
大正製薬ホールディングス	28.1	35	199,150	東京製鋼	4.5	6.4	8,652	L I X I L	161	228.9	575,912
ペプチドリーム	60.1	77.1	155,742	大阪製鐵	6.3	7.9	9,653	日本フィルコン	8.5	10.9	5,831
あすか製薬ホールディングス	-	16.8	17,421	淀川製鋼所	15.9	19.3	50,373	ノーリツ	24.3	28	45,780
サワグル-ホールディングス	-	32.2	145,061	丸-鋼管	37.9	51.5	136,063	長府製作所	12	14.9	28,980
<b>石油・石炭製品 (0.4%)</b>				モリ工業	3.5	4.5	11,403	リンナイ	22.7	27.4	277,014
日本コークス工業	100.5	123.8	17,332	大同特殊鋼	19.1	23.8	102,340	ダイニチ工業	5.7	7.2	5,133
ニチレキ	14	18.9	24,381	日本高周波鋼業	4	4.2	1,428	日東精工	15.1	18.4	9,568
ユシロ化学工業	6.8	7.9	8,500	日本冶金工業	9.1	10.8	31,968	三洋工業	1.3	1.4	2,532
ピーピー-カストロール	4.3	5.5	7,155	山陽特殊製鐵	14	15	33,135	国際	24.1	27.8	20,822
富士石油	28.8	39.4	10,086	愛知製鐵	6.6	8.2	21,197	ショーテフト	14.6	18.2	26,080
MORESCO	4.5	5.1	5,997	日立金属	110.3	156.7	327,189	東レ	21.9	27.1	33,360
出光興産	131.2	163.3	502,147	日本金属	2.9	3.6	3,880	高周波熱鍊	22.3	25.9	15,306
ENEOSホールディングス	1,778.3	2,210.8	1,036,201	大太平洋金属	7.8	8.9	26,619	東京製鋼	8.2	8.9	7,885
コスモエネルギーホールディングス	37.3	42.6	101,217	新日本電工	75.3	93.6	30,513	サンコ-ル	10.3	12.9	7,198
<b>ゴム製品 (0.7%)</b>				栗本鐵工所	5.4	6.8	10,608	モリテックスチール	9	11.4	3,693
横浜ゴム	68.4	85	145,350	虹 技	1.3	2.3	2,178	パイオラックス	17.3	21.6	38,750
TOYO TIRE	62.2	77.5	126,557	日本鑄鉄管	1.4	1.6	1,601	エイチワン	11.6	14.4	9,432
ブリヂストン	314.4	423.6	2,201,872	三菱製鋼	8.8	9.2	11,546	日本発条	116.4	133.7	120,330
住友ゴム工業	106	132.1	156,934	日亜鋼業	17.8	19.5	5,401	中央製條	1	7.2	5,724
藤倉コンポジット	10.8	11.9	9,674	日本精線	1.7	2.5	11,200	アドパネクス	1.6	2.2	3,260
オカモト	7.3	8.8	36,168	エンビロ-ホールディングス	5.1	4.8	8,016	立川プラインド工業	5.3	6.7	7,370
フコク	4.4	6.6	6,355	シンニツタン	14.5	18	4,230	三益半導体工業	9.1	11.5	27,370
ニッタ	12.2	15.3	43,084	新家工業	3.1	3.8	6,429	<b>機械 (5.3%)</b>			
住友理工	22.8	28.7	17,220	<b>非鉄金属 (0.8%)</b>				日本ドライケミカル	3	3.8	6,623
ニッ星ベルト	14.4	17.9	38,234	大紀アルミニウム工業所	17.7	22	32,186	日本製鋼所	35.5	44.1	165,375

銘柄				銘柄				銘柄			
期首(前期末)		当期末		期首(前期末)		当期末		期首(前期末)		当期末	
株数	千株	株数	千株	株数	千株	株数	千株	株数	千株	株数	千株
	千円	評価額	千円		千円		千円		千円		千円
三浦工業	50.6	63	207,585	帝国電機製作所	8.3	10.6	13,939	三菱重工業	185.7	231	737,583
タフマ	39.6	49.2	70,060	東京機械製作所	4.3	—	—	IHI	79.5	91.8	214,353
ツガミ	24.2	31.9	41,629	新東工業	28.2	32.6	22,689	サノリスホールディングス	15.5	17	2,227
オークマ	13.6	16.9	81,458	澁谷工業	10.4	12.8	32,256	スター精密	18.2	22.8	33,288
芝浦機械	12.2	16.5	50,902	アイチコーポレーション	20.5	21.7	17,967	<b>電気機器 (18.0%)</b>			
アマダ	171.2	229.4	251,651	小森コーポレーション	30.1	37.5	26,100	日清紡ホールディングス	72	89.8	88,812
アイダエンジニアリング	30.7	38.2	39,498	鶴見製作所	9.2	11.5	19,630	イビデン	56.8	77.2	465,516
滝澤鉄工所	3.9	4.8	5,726	住友精密工業	1.9	2.4	4,524	コニカミノルタ	239.4	320.9	159,808
F U J I	46.6	67	168,103	日本ギア工業	6	6	1,578	ブラザー工業	144.3	179.5	398,490
牧野フライス製作所	13.7	16	60,320	酒井重工業	1.9	2.7	7,641	ミネベアミツミ	203.7	253.4	676,831
オーエスジー	57.6	67.3	136,551	荏原製作所	49	61.1	338,494	日立製作所	568.4	707.2	4,163,993
ダイジェット工業	1	1.1	1,083	石井鐵工所	1.2	1.2	3,584	東芝	—	256.9	1,233,120
旭ダイヤモンド工業	31	38.3	23,133	西島製作所	12.2	13.5	12,433	三菱電機	1,182.4	1,470.1	2,072,841
DMG森精機	73.9	86.3	149,557	北越工業	12.4	14	12,600	富士電機	71.2	88.6	526,284
ソディック	25.6	32.2	25,599	ダイキン工業	150.6	187.4	4,194,949	東洋電機製造	4.7	5.9	5,658
ディスコ	15.9	21.5	693,375	オルゴン	3.8	4.2	32,550	安川電機	127.3	158.4	760,320
日東工器	5.7	8.1	13,024	トーヨーカネツ	4.4	5.5	14,069	シンフオンテクノロジー	15.4	17.7	22,319
日進工具	4.6	11.6	16,576	栗田工業	64	79.7	379,770	明電舎	20	24.9	61,104
パンチ工業	9.9	12.2	5,990	榑本チエイン	16.9	19.4	62,856	オリジン	2.6	4	5,032
富士ダイス	6.4	6.8	4,182	大同工業	4.6	6.7	6,231	山洋電気	5.7	6.6	32,802
豊和工業	6.5	7.9	6,557	木村化工機	9.8	12.2	9,064	デンヨー	10.1	12.6	21,092
OKK	4.8	5.6	4,244	アネスト岩田	20	23	18,653	PHCホールディングス	—	16.9	27,124
石川製作所	3	3.9	5,752	ダイフク	65.1	81	690,930	東芝テック	12.7	16	79,120
東洋機械金属	8.4	9.9	5,613	サムコ	2.9	3.6	8,067	芝浦メカトロニクス	2.1	2.7	22,464
津田駒工業	2.4	3.4	1,975	加藤製作所	6.4	6.9	5,837	マブチモーター	32.7	34.1	122,760
エンシュウ	2.4	3.5	2,289	油研工業	1.7	1.8	3,117	日本産産	284.6	381.1	3,803,759
島精機製作所	17.1	21.2	37,078	タダノ	57	77	74,998	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7	6.6	2,534
オプトラン	14.6	18.3	42,016	FJジテック	40.8	54.6	147,420	トレックス・セミコンダクター	6.4	7.5	19,740
NCホールディングス	3.1	4.1	6,629	CKD	27.4	43.4	89,317	東光高岳	6	8.2	11,783
イワキ	7.6	9.4	9,428	キトー	10	12.6	21,256	ダブル・スコープ	23.2	42.3	33,163
フリュー	11.5	12.8	16,473	平和	32.9	41.1	78,090	ダイヘン	12.9	16.1	64,319
ヤマシンフィルタ	23.5	29.3	11,221	理想科学工業	9.2	12.3	27,416	ヤーマン	19.3	24	21,456
日阪製作所	14.8	18.3	15,060	SANKYO	28	31.8	96,513	JVCケンウッド	101.9	119.5	22,346
やまびこ	22.6	28.3	29,941	日本金銭機械	13.2	15	9,660	ミキエンジニアリング	11	13.3	10,374
野村マクロ・サイエンス	—	3.9	16,282	マースグループホールディングス	7.6	9.4	15,199	I-P-E-X	5.5	6.9	11,854
平田機工	5.5	6.9	39,054	フクシマガリレイ	8.1	10.3	43,105	日新電機	27.7	34.7	50,696
ベガサスミシン製造	12.2	15	8,565	オーイズミ	5.1	5.4	2,133	大崎電気工業	23.4	26.8	12,810
マルマエ	4.3	6	14,268	ダイコク電機	5.6	6.9	8,583	オムロン	98.4	122.4	1,006,984
タツモ	4.9	6.9	9,694	竹内製作所	19.7	22.4	63,212	日東工業	17.3	19.6	30,830
ナプテスコ	68.9	82.9	290,564	アマノ	31	38.5	84,199	I D E C	15.9	18.3	42,639
三井海洋開発	12.4	15.5	18,693	JUKI	16.5	20.5	15,723	正興電機製作所	2.7	4.6	4,774
レオン自動機	11.4	15.6	16,270	サンデン	16.5	20.4	3,957	不二電機工業	2.3	3.4	3,672
S M C	34.6	43.1	2,754,521	ジャノメ	10.6	12.5	9,062	ジーエス・ユサフ コーポレーション	42.4	47.9	108,733
ホソカワミクロン	4.1	10.3	29,530	マックス	16.3	19.7	34,947	ザクサホールディングス	2.8	2.9	3,822
ユニオンツール	4.4	5.5	20,405	グローリー	30.4	37.7	78,755	メルコホールディングス	4.1	3.3	12,490
オイレ工業	16.5	20.5	33,066	新晃工業	11	13.8	25,267	テクノメディカ	2.8	3.5	5,533
日精工・エス・ビー機械	3.4	4.9	14,327	大和冷機工業	19	21.2	23,977	ダイヤモッドレックトリックホールディングス	3.4	4.1	4,374
サトーホールディングス	15.4	19.3	39,121	セガサミーホールディングス	107.5	145.9	302,158	日本電気	150.2	186.9	949,452
技研製作所	10.3	12.8	49,792	日本ビストロリング	4.5	5.4	7,225	富士通	106.4	132.4	2,133,626
日本エアテック	3.8	6.8	7,459	リケン	5.5	6.4	17,299	沖電気工業	47.9	59.8	53,521
カワタ	3.2	4.7	5,010	T P R	16	19.9	29,631	岩崎通信機	4.4	6.3	5,134
日精樹脂工業	3.2	10.4	10,649	ツバキ・ナカシマ	22.5	32.2	46,657	電気興業	5.7	7.9	18,264
オカダアイオン	9.8	4.7	6,909	ホシザキ	37.2	43	373,240	サンケン電気	13.8	13.8	65,274
ワイエイシイホールディングス	4.6	5.7	7,022	大豊工業	9.8	12	8,592	ナカヨ	1.9	2.2	2,494
小松製作所	535.7	666.1	1,878,068	日本精工	242.6	276.6	206,620	アイホン	6.8	8.5	18,156
住友重機械工業	67.6	84.1	249,356	NTN	272.6	314.8	73,348	ルネサスエレクトロニクス	508.7	796.7	1,000,655
日立建機	55.3	58.9	172,577	ジェイテクト	113.3	140.9	147,663	セイコーエプソン	146.6	182.4	335,980
日工	17.6	20.4	12,444	不二越	11	12.6	53,109	ワコム	85.5	114	101,688
巴工業	4.8	5.9	13,044	日本トムソン	32.2	40.2	24,964	アルバック	21.8	29.3	172,870
井関農機	11.8	13.7	18,303	T H K	73.7	83	233,977	アクセル	4.9	6.3	6,545
T O W A	11	12.6	30,769	ユーシン精機	7.9	11.7	8,154	E I Z O	10	11.5	42,435
丸山製作所	2.4	3.2	4,793	前澤給装工業	4.2	11.4	11,149	ジャパンディスプレイ	404	500	19,000
北川鉄工所	5.5	6.8	9,526	イーグル工業	14.7	18.3	19,599	日本信号	27.6	37.5	33,975
ローツェ	5.2	7.4	75,924	前澤工業	7.3	8.9	5,936	京三製作所	25.4	31.6	13,272
タカキタ	4.3	5	3,050	日本ビラー工業	12.1	14.9	46,190	能美防災	15.7	19.5	40,540
クボタ	621.2	712.6	1,707,745	キッツ	36.6	49.7	33,000	ホーチキ	8.6	10.9	13,178
荏原実業	2.9	6.9	15,035	マキタ	154.2	179	711,883	星和電機	5.9	7.2	3,916
三菱化工機	3.7	4.7	9,494	三井E&Sホールディングス	45.7	53	19,610	エレコム	13.5	33.7	46,000
月島機械	21.8	27.3	28,310	日立造船	93.7	124.3	92,354	パナソニック	1,260.9	1,568.1	1,884,072



銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	株 数	株 数	評 価	額		株 数	株 数	評 価	額		株 数	株 数	評 価	額	
シャープ		千株		千円	カシオ計算機		千株		千円	本田技研工業		千株		千円	
アンリツ	136.8	167.6	208,997		ファナック	95.1	106.5	148,780		930.9	1,157.5	3,938,972			
富士通ゼネラル	71	94.6	149,562		日本シイエムケイ	103.8	129.1	2,875,057		スズキ	234.4	336.2	1,614,768		
ソニーグループ	36.2	39.9	97,994		エンプラス	25.5	28.9	16,241		S U B A R U	338.8	421.2	847,665		
T D K	740.6	921.1	11,661,126		大真空	5.3	3.6	9,478		安永	5.7	7.2	6,278		
帝国通信工業	57.1	213	970,215		ローム	4	19.9	24,297		ヤマハ発動機	167.1	191.9	532,906		
タムラ製作所	5.6	6.7	9,112		浜松ホトニクス	49.2	65.8	604,044		T B K	11.8	16.9	6,929		
アルプスアルパイン	42.3	56.8	36,749		三井ハイテック	84.8	105.5	612,955		エグセディ	16	22.3	37,664		
池上通信機	96.5	129.9	164,713		新光電気工業	11.6	14.6	124,100		豊田合成	38.2	47.4	106,507		
日本電波工業	4	5	3,215		京セラ	39.7	43.2	214,920		菱三工業	18.5	23.1	17,094		
鈴木	11.5	13.3	16,651		太陽誘電	180.2	206.9	1,416,437		盟和産業	1.6	1.7	1,723		
メイコー	5.3	6.8	5,882		村田製作所	52.5	71.3	377,177		日本プラス	10.3	11.5	6,428		
日本トリム	—	12	44,700		双葉電子工業	347.3	431.9	3,556,264		ヨロズ	10.2	13.9	14,011		
ローランド ディー. ジー.	2.5	2.9	8,816		ニチコン	20.3	25.1	16,892		エフ・シー・シー	19.3	24	34,248		
フォスター電機	7	8.7	22,985		キヤノン	4.6	5.5	6,897		シマノ	44.3	59.1	1,533,054		
S M K	12.4	14.8	11,928		日本ケミコン	37.1	46.3	55,467		テイ・エス テック	27.4	62.1	97,000		
ヨコオ	3.1	3.5	7,570		K O A	11.9	14	26,082		ジャムコ	7	8.6	7,146		
ティアック	8.7	10.9	28,656		SCREENホールディングス	16.3	22.3	32,290		<b>精密機器 (2.7%)</b>					
ホンデン	7.3	23.5	3,125		小糸製作所	17.6	17.7	9,062		テルモ	362.5	416	1,724,320		
ヒロセ電機	32.2	35.4	42,480		ミツバ	70.8	80.7	472,095		クリエイトメディック	4.2	4.3	4,166		
日本航空電子工業	18.2	22.8	393,984		東京エレクトロン	21.7	27	11,205		日機装	38.2	44.1	37,529		
T O A	27	33.7	61,738		キャノン電子	20.5	25.6	288,000		日本エム・ディ・エム	6.8	8.6	13,837		
マクセル	14	16	12,432		キヤノン	10.9	13.7	22,084		島津製作所	152.2	189.3	779,916		
古野電気	23.4	29.3	36,039		リコー	587.5	730.5	2,043,939		J M S	10	12.3	7,576		
ユニテホールディングス	15.1	17.4	18,339		象印マホービン	300.7	408.1	400,754		グボテック	3.1	3.3	858		
スミダコーポレーション	3	3.3	11,913		MUTOHホールディングス	31.9	39.8	58,625		長野計器	8.5	10.8	14,450		
アイコム	10	13.9	13,538		東京エレクトロン	1.2	1.2	2,510		ブイ・テクノロジ	5.5	6.4	21,760		
リオン	4.9	5.5	12,980		<b>輸送用機器 (8.7%)</b>	69.3	93.3	5,156,691		東京計器	7.5	9.4	9,559		
本多通信工業	9.4	11.9	5,712		トヨタ紡織	34.5	60	130,800		愛知時計電機	1.2	3.7	7,074		
船井電機	13.4	—	—		芦森工業	2.4	2.5	2,242		インターアクション	5.9	7.5	14,685		
横河電機	118.3	147.2	274,969		ユニプレス	19.3	21.9	17,936		オーバル	10.7	13.3	3,564		
新元元工業	4.5	5.6	18,900		豊田自動織機	95.7	119.2	1,060,880		東京精密	19.9	24.8	112,592		
アズビル	80	86.2	359,023		モリタホールディングス	19	23.6	29,854		マニ	47	58.6	96,865		
東亜ディーケーケー	6.1	7.6	6,878		三機工業	16.3	20.2	16,846		ニコン	180.4	224.5	292,972		
日本光電工業	48.9	60.9	188,790		デンソー	260.4	323.7	2,751,450		トプコン	59.5	69.1	102,682		
チノー	3.8	4.8	7,862		東海理化電機製作所	31.2	38.8	59,946		オリンパス	654.2	771.1	1,744,999		
共和電業	13	14.9	5,632		川崎重工	91.9	107.3	233,055		理研計器	10.5	12	63,000		
日本電子材料	4.3	7.2	16,516		名村造船所	35.7	43.7	8,827		タムロン	9.5	11.5	28,911		
堀場製作所	23.4	27.3	165,165		日本車輛製造	4.3	5.5	11,000		H O Y A	234.6	287	4,439,890		
アドバンテスト	87.9	109.3	1,007,746		三菱ロジスネクスト	15.7	19.5	19,929		シード	5.2	6.9	3,608		
小野測器	4.3	6.9	3,312		近畿車輛	1.6	1.7	1,847		ノーリツ鋼機	10.6	13.2	27,508		
エスベック	10.5	12	24,168		日産自動車	1,394.4	1,733.9	1,038,432		イー・アンド・デイ	9.9	13.4	12,730		
キーエンス	11.6	133.2	7,826,832		いすゞ自動車	342.6	461.4	687,947		朝日インテック	124.4	161.2	312,728		
日置電機	5.7	7	44,240		トヨタ自動車	1,197.8	7,450.7	16,954,067		シチズン時計	149.2	172.1	86,910		
シスメックス	92.2	124.4	1,316,774		日野自動車	147.7	183.6	194,616		リズム	3.1	4.6	6,026		
日本マイクロニクス	20.6	25.6	38,476		三菱自動車工業	437.1	544.1	171,935		大研医器	9.5	12	6,324		
メガチップス	11.9	13.8	57,339		エフテック	8.4	10.3	5,562		メニコン	18.1	48.8	132,540		
O B A R A G R O U P	7	6.8	22,236		レシップホールディングス	4.6	5.7	3,192		シンシア	1.2	1.8	957		
澤藤電機	1.3	1.8	2,649		G M B	2.2	2.8	2,282		松風	5.5	6.4	12,268		
原田工業	5	7.5	7,357		ファルテック	2.3	2.9	2,105		セイコーホールディングス	16.6	20.7	45,602		
コーセル	14.4	16.3	13,219		武蔵精密工業	26.4	32.7	57,421		ニプロ	88.1	109.6	117,052		
イリソ電子工業	9.9	12.3	52,152		日産車体	17.3	21.7	15,428		<b>その他製品 (2.3%)</b>					
オプテックスグループ	19.4	24	35,256		新明和工業	33.3	41.7	38,072		中本パックス	3.1	4.2	7,274		
千代田インテグレイ	5.1	6.4	11,936		極東開発工業	20.4	27.3	39,666		スノーピーク	7	19.3	44,544		
アイ・オー・データ機器	4.4	5.5	4,713		トビー工業	9.8	12.1	13,467		パタマンヘッドホールディングス	11.4	28.2	54,538		
レーザーテック	51.9	64.5	1,435,447		ティアド	3.7	4.2	11,919		トランザクション	6.4	8.1	8,245		
スタンレー電気	82.9	102.8	274,064		曙ブレーキ工業	64.1	80.6	13,863		粧美堂	3	5	2,065		
岩崎電気	4.3	5.4	12,144		タチエス	18.1	25.7	31,122		ニホンフラッシュ	10.1	12.6	13,393		
ウシオ電機	60.6	75.3	1,397,079		N O K	57.2	71.2	91,207		前田繊維	13	16.3	51,426		
岡谷電機産業	8.9	9.3	2,929		フタバ産業	29.6	36.8	15,124		永大産業	16.8	20.5	6,293		
ベリオス テクノ ホールディング	11.2	12.9	3,715		K Y B	13.2	15.4	47,124		アートネイチャー	11.6	12.7	8,801		
エノモト	3.3	4	6,408		大同メタル工業	24.6	28.5	18,126		バンダイナムコホールディングス	97.8	131.8	1,124,385		
日本セラミック	12	13.8	34,610		プレス工業	58.5	73	27,813		アイフィスジャパン	3.2	4.3	2,893		
遠藤照明	6.7	6.9	6,817		ミクニ	16.1	19.6	8,976		共立印刷	21.9	25.1	3,614		
古河電池	8.4	10.7	13,171		太平洋工業	24.8	30.8	33,140		S H O E I	10.4	13.9	60,812		
双信電機	5.8	6.4	3,718		河西工業	16.2	17.7	5,557		フランスベッドホールディングス	15.4	19.3	17,427		
山一電機	7.6	10.8	23,630		アイシン	86.5	107.7	487,342		パイロットコーポレーション	20.9	24.9	104,829		
図研	7.7	9.5	28,376		マツダ	370.8	461.4	406,954		萩原工業	6.7	9.6	11,529		
日本電子	21.6	30.8	192,500		今仙電機製作所	10.4	9.6	5,712		トッパン・フォームズ	21.2	—	—		
										フジシーリングインターナショナル	24.3	35.7	76,540		













銘柄	期首(前期末)		当期		株 数	株 数	千 円	株 数	株 数	千 円	銘柄	期首(前期末)		当期		株 数	株 数	千 円	銘柄	期首(前期末)		当期		株 数	株 数	千 円		
	株	数	株	数								株	数	株	数					株	数	株	数				株	数
キャリアデザインセンター	2.5	3.6	4,194		リソルホールディングス	0.9	1.6	7,000	プロレド・パートナーズ	1.6	3	2,436																
ベネフィット・ワン	41.2	51.2	153,548		テクノプロ・ホールディングス	22.5	84.1	295,191	and factory	1	3.3	1,214																
エムスリー	199.3	247.9	1,042,667		アトラグループ	2.5	2.6	676	テノ・ホールディングス	0.9	2	1,206																
ツカガ・グローバルホールディング	9.5	8.5	2,380		インターワークス	3.5	4.5	1,687	7フロンティア・マネジメント	2	3.6	2,350																
プラス	1.5	2.2	1,392		アイ・アールジャパンホールディングス	4.6	6.6	32,505	ピアラ	0.6	2.3	1,258																
アウトソーシング	64.7	80.5	108,514		KeepPer 技研	7.3	9	16,929	コブ・ホールディングス	0.6	2.9	3,204																
ウエルネット	11.5	14.3	6,263		ファーストロジック	2.2	2.9	2,166	ゲンクス	1.5	2.6	3,803																
ワールドホールディングス	3.9	5.6	13,484		三機サービス	2.3	3	2,907	カープホールディングス	31	38.7	27,244																
ディー・エヌ・エー	47.8	53.6	95,783		Gunosy	6.8	8.8	6,274	フォーラムエンジナリング	5.8	9.9	8,613																
博報堂DYホールディングス	157.2	195.6	350,124		デザインワン・ジャパン	3.5	3.6	673	FAST FITNESS JAPAN	-	2	4,224																
ぐるなび	19.6	22.9	8,724		イー・ガーディアン	4.9	5.6	14,795	ダイレクトマーケティングミックス	4.4	15.2	21,964																
タカミヤ	14.1	17.6	7,128		リブセンス	6.2	8.7	1,400	ボビンスホールディングス	2.3	3.4	8,493																
ジャロバストレスキューシステム	8.9	9.4	8,610		ジャパンマテリアル	34.8	43.2	71,625	LITALICO	-	11.5	35,190																
ファンコミュニケーションズ	31.3	35.1	13,267		ベクトル	14	19.7	20,448	アドレティックスマネジメント	5.7	7.2	5,184																
ライク	3	3.8	6,805		ウチヤマホールディングス	5.8	7.4	2,412	リリコグループ	61.7	76.9	158,337																
ビジネス・ブレイクスルー	5.1	5.5	2,304		チャーム・ケア・ソリューション	8.4	10.6	12,084	東祥	7.1	10.6	16,472																
エスピーール	28.9	39.7	39,342		キャリアリンク	3.6	5.1	8,573	TRUEホールディングス	-	19.4	28,731																
WDBホールディングス	5.2	6.6	18,513		IBJ	9.1	11.5	8,728	人・夢・技術グループ	-	5.6	10,102																
時間いらず	1.1	1.8	8,496		アサンテ	4.1	6.4	10,419	エイチ・アイ・エス	16.4	31.3	64,165																
ティア	7.2	8.7	3,801		N・フィールド	7.6	-	-	ラックランド	3.2	4.1	11,836																
CDG	1.3	1.4	1,912		バリュウーHR	4.5	5.6	13,904	共立メンテナン	18.7	25	103,875																
アドウェイズ	13.7	20.9	15,863		M&Aキャピタルパートナーズ	9.3	11.6	55,042	イチネンホールディングス	11.8	14.6	18,804																
バリューコマース	7.5	11.2	39,032		ライオンシステムホールディングス	4.3	5.4	8,262	建設技術研究所	7.3	8.5	20,102																
インフォマート	114.3	153.9	97,880		ER1ホールディングス	2.8	4	4,660	スペース	7.7	10.4	9,505																
J Pホールディングス	32.6	35.7	8,246		アビスト	1.8	2.2	6,435	長 大	4.5	-	-																
Eコナックホールディングス	20.7	26	2,288		ジグマシステムホールディングス	6.2	8.6	19,049	燦ホールディングス	4.7	6.3	9,714																
E P Sホールディングス	15.3	-	-		ウィルグループ	8.2	10.4	13,176	スパル興業	0.7	0.7	5,537																
C Lホールディングス	2.7	3	3,594		エスコロー・エージェント・ジャパン	16.6	18.9	3,553	東京データル	4.6	5.4	6,615																
フステージ・インターナショナル	42.2	52.4	37,832		メドピア	5.3	10.9	30,498	タナベ経営	2.2	4.8	3,028																
アマユーズ	6.2	7.7	16,216		レアジョブ	1.6	2.8	2,282	ナガワ	3.6	4.6	43,608																
ドリームインキュベータ	3.5	3.9	8,088		リクルートホールディングス	809.3	1,083.7	6,140,244	よみうりランド	0.6	-	-																
クイック	7	9.6	15,801		エラン	15.6	19.4	19,826	東京競馬	7.3	10.7	46,224																
T A C	6.3	8.6	1,952		土木管理総合試験所	5.7	6.9	2,187	常磐興産	4.7	5.4	7,317																
ケネディクス	32.3	-	-		ネットマーケティング	5.4	6.9	3,029	カナモト	19.9	24.8	57,015																
電通グループ	127	144.8	605,988		日本郵政	855.3	1,834.3	1,880,157	東京ドーム	44.5	-	-																
ディクアンドガ・ニーズ	5.2	6.7	6,880		ベルシスシステム24ホールディングス	18.9	20.1	28,642	西尾レントオール	10.4	12.9	36,894																
びあ	3.2	4.9	16,415		鎌倉新書	11.4	16	8,400	アサヒ ホスピタリティ・グループ	71.2	75.2	1,654																
イオンファンタジー	4.3	5.4	11,718		SMN	2.4	3.4	2,046	トランス・コスモス	10.8	17.9	57,101																
シーティーエス	12.6	16	12,976		一蔵	1.7	2.3	899	乃村工藝社	48.3	60.2	57,671																
ネクシースグループ	3.5	5	3,445		LITALICO	4.6	-	-	藤田観光	4.4	6.2	15,196																
H. U. グループホールディングス	31.7	36.7	108,411		グローバルキックCOMPANY	2.1	2.7	2,130	KNT-CTホールディングス	6	8.7	12,754																
アルプス技研	10	12.6	23,347		エマトリ	6.1	9	27,270	日本管財	12.2	15.1	42,083																
サンックス	17.7	24.4	4,733		アトラエ	3.4	9.8	20,482	トーカイ	11	12.5	22,887																
ダイオーズ	2.2	3.5	3,475		ストライク	4.2	5.3	21,995	白洋舎	1	1.7	2,050																
日本空調サービス	12.2	15	11,730		ソラスト	27.7	34.5	36,570	セコム	111.3	138.5	1,147,749																
オリエンタルランド	120.1	166.1	3,474,812		セラク	3.5	4.6	5,602	セントラル警備保障	5.4	6.8	16,109																
ダスキン	26.2	32.6	89,650		インソース	9.4	13.7	26,112	丹青社	21.1	28.7	20,635																
明光ネットワークジャパン	14.2	16.5	9,322		ベイカレント・コンサルティン	7.4	9.9	402,435	メイテック	13.8	17	113,900																
ファコホールディングス	5.4	6.8	14,048		Orchestra Holdings	2.5	2.8	7,834	応用地質	13.2	16	34,160																
秀英予備校	2.8	3.6	1,519		アイモパイル	4	4	4,660	船橋総研ホールディングス	23.1	28.8	66,643																
田谷	1.7	1.8	991		キャリアインデックス	4.6	4.8	3,609	進学会ホールディングス	4.9	5.1	1,672																
ラウンドワン	38.5	39.2	57,310		MS-Japan	4.5	5.7	5,061	オオバ	7.9	10.2	7,405																
リゾートトラスト	51.7	64.4	123,390		船場	1.6	1.7	1,269	いであ	2.7	3.9	6,953																
ビー・エム・エル	14.6	18.2	66,339		グレイステックロジ	5.7	-	-	学究社	3.4	4.7	7,219																
ワタベウェディング	1.7	-	-		ジャロバエレクトロニクスホールディングス	32.5	44.5	71,422	パネットホールディングス	41.4	46.8	106,516																
りらいあコミュニケーションズ	17.1	21.3	21,917		フルテック	1.8	2.2	2,893	イオンデパート	13.9	17.3	52,332																
リゾー教育	57.3	64.3	26,105		グリーンズ	4.2	5.3	2,501	ナック	5.6	7.4	7,266																
早稲田アカデミー	4.4	8	8,104		ツナグループ・ホールディングス	1.7	3.4	1,030	ダイセキ	18.9	26	127,270																
ユー・エス・エス	126.4	157.3	299,656		GAMEWITH	3.5	4.3	1,917	ステップ	4.3	5.3	9,481																
東京個別指導学院	9.9	12.3	7,699		ソウルドアウト	2.7	3.5	3,174																				
サイバーエージェント	69.6	346.2	508,221		MS&Consulting	1.9	2.4	1,576																				
楽天グループ	526.6	721.4	705,529		ウエルビー	-	9.1	11,129																				
クレーク・アンド・リバー社	5.8	7.5	13,087		エル・ディー・エス	0.8	1.8	4,152																				
モーニングスター	12.8	24.7	14,424		ミダックホールディングス	2.4	6.2	15,710																				
デー・オー・ダブリュー	19.8	24.8	7,489		日総工業	8.7	11	8,558																				
山田コンサルテックグループ	6.6	7.5	8,565		キューベネットホールディングス	5.2	6.6	11,180																				
セントラルスポーツ	4.2	5.2	12,844		RP Aホールディングス	12.8	19.7	7,052																				
フルキャストホールディングス	9.8	12	26,460		スプリックス	3.2	4	5,788																				
エン・ジャパン	20.1	22.9	66,341		マネジメントソリューションズ	5.5	6.9	22,770																				
株数・金額	124,117.8	161,644	387,140,847		株数・金額	12,183.6	2,174.8	1,991,044.9																				
銘柄数<比率>	124	161	387		銘柄数<比率>	12	2	1,991																				

(注1) 銘柄毎の( )内は、期末の国内株式評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

## (2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	T O P I X	百万円 10,035		百万円 -

## ■投資信託財産の構成

2022年2月7日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 387,140,847		% 96.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	12,580,070		3.1
投 資 信 託 財 産 総 額	399,720,917		100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。



■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	399,670,143,174円
一 般 株 式 (評 価 額)	11,420,891,042
株 未 取 入 式 (評 価 額)	387,140,847,090
株 未 取 入 式 (評 価 額)	11,243,540
株 未 取 入 式 (評 価 額)	655,237,202
株 未 取 入 式 (評 価 額)	441,924,300
(B) 負 債	2,333,527,720
負 債	909,720
負 債	2,332,618,000
(C) 純 資 産	397,336,615,454
純 資 産	124,570,625,521
純 資 産	272,765,989,933
(D) 受 益 権 益 総 額	124,570,625,521円
受 益 権 益 総 額	31,896円

(注1) 期首元本額 102,109,610,506円  
 追加設定元本額 163,175,331,486円  
 一部解約元本額 140,714,316,471円

(注2) 期末における元本の内訳  
 MHAMスリーウェイクオープン 561,857,238円  
 MHAM TOP I X オープン 2,725,686,605円  
 MHAM日本株式インデックスファンド (ファンドラップ) 7,087,968,915円  
 One DC 国内株式インデックスファンド 20,422,344,253円  
 D I AM国内株式バッシブ・ファンド 4,704,569,337円  
 M I T O ラップ型ファンド (安定型) 3,424,028円  
 M I T O ラップ型ファンド (中立的) 23,972,661円  
 M I T O ラップ型ファンド (積極型) 78,308,323円  
 グローバル8資産ラップファンド (安定型) 28,249,023円  
 グローバル8資産ラップファンド (中立的) 21,103,225円  
 グローバル8資産ラップファンド (積極型) 15,896,115円  
 たわらノーロード TOP I X 1,306,069,812円  
 たわらノーロード バランス (8資産均等型) 1,033,861,326円  
 たわらノーロード バランス (堅実型) 40,906,841円  
 たわらノーロード バランス (標準型) 262,619,504円  
 たわらノーロード バランス (積極型) 394,664,404円  
 たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型) 3,669,806円  
 たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型) 174,139,464円  
 たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) 434,342,242円  
 たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型) 283,511,087円  
 たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型) 405,598,982円  
 たわらノーロード 最適化バランス (保守型) 705,164円  
 たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 2,916,286円  
 たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 36,588,931円  
 たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 6,020,593円  
 たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 19,092,798円  
 D I AM国内株式インデックスファンド<DC年金> 34,009,153,068円  
 Oneグローバルバランス 5,199,858円  
 D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型 1,065,319,872円  
 D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型 3,512,005,009円  
 D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型 3,794,173,475円  
 D I AM DC バランス30インデックスファンド 3,343,318,358円  
 D I AM DC バランス50インデックスファンド 1,113,385,483円  
 D I AM DC バランス70インデックスファンド 1,115,312,187円  
 マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) 30,317,366円  
 マネックス資産設計ファンド (育成型) 1,055,563,450円  
 マネックス資産設計ファンド エゴリユーション 18,529,124円  
 D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10) 304,544,955円  
 D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20) 306,459,778円  
 D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30) 545,764,310円  
 投資のソムリエ 13,743,021,171円  
 フルーズコントロール 128,837,057円  
 投資のソムリエ<DC年金> 831,424,634円  
 D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金> 337,759,108円  
 4資産分散投資・ハイクラス<DC年金> 549,884,906円  
 D I AMコア資産設計ファンド (堅実型) 1,701,235円  
 D I AMコア資産設計ファンド (積極型) 5,513,567円  
 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 559,030,369円  
 リスク抑制世界8資産バランスファンド 3,846,898,552円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045) 41,503,360円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055) 20,515,309円  
 リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) 4,618,660円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035) 146,712,017円  
 4資産分散投資・スタンダード<DC年金> 348,653,940円  
 リスクコントロール世界資産分散ファンド 2,393,008,159円  
 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 279,145,423円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040) 42,977,458円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050) 17,916,384円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060) 15,092,602円  
 4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金> 105,875,155円  
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065) 985,477円  
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定) 22,944,960円  
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定) 23,431,080円  
 マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定) 21,508,092円  
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定) 14,273,870円  
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定) 22,637,856円  
 インカム重視マルチアセット運用ファンドI2021-04 (適格機関投資家限定) 193,585,816円  
 マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-05 41,677,610円  
 マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型) 21-06 84,110,969円  
 マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-07 68,984,011円  
 マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-08 47,924,787円  
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定) 22,733,018円  
 マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-09 49,987,822円  
 マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-12 70,694,127円  
 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) 329,597,803円  
 D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定) 34,825,039円  
 日米興業戦略ファンド (インカム重視) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定) 116,640,502円  
 インカム重視マルチアセット運用ファンド (FOF5用) (適格機関投資家限定) 39,121,859円  
 リスクコントロール8資産/ラップファンド (FOF5用) (適格機関投資家専用) 7,907,522円  
 D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 57,045,218円  
 D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 101,888,672円  
 D I AM国際分散/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 4,956,036円  
 D I AM国際分散/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 26,722,846円  
 D I AM国内重視/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 5,712,676円  
 D I AM国内重視/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 1,338,373円  
 D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) 7,152,634円  
 D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 34,835,196円  
 D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 557,427,217円  
 D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) 634,827,723円  
 D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定) 1,809,585,772円  
 D I AMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定) 31,302,862円  
 D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定) 31,388,733円  
 D I AM アサahiグローバル/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) 301,727,248円  
 D I AM世界アセット/バランスファンドVA (適格機関投資家限定) 74,733,048円  
 D I AM世界/バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) 1,406,645円  
 D I AM世界アセット/バランスファンド2VA (適格機関投資家限定) 349,638,985円  
 D I AM世界アセット/バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) 20,826,409円  
 D I AM世界アセット/バランスファンド25VA (適格機関投資家限定) 73,311,471円  
 D I AM世界アセット/バランスファンド3VA (適格機関投資家限定) 173,199,524円  
 D I AM世界アセット/バランスファンド4VA (適格機関投資家限定) 237,769,545円  
 D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定) 38,321,734円  
 D I AM国内バランス30VA (適格機関投資家限定) 18,177,991円  
 D I AM世界アセット/バランスファンド7VA(121) (適格機関投資家限定) 291,737,796円  
 D I AM世界アセット/バランスファンド7VA(1303) (適格機関投資家限定) 936,557,239円  
 D I AM世界アセット/バランスファンド7VA(1306) (適格機関投資家限定) 1,240,495,959円  
 D I AM世界アセット/バランスファンド7VA(1309) (適格機関投資家限定) 49,936,951円  
 動的パッケージファンド<DC年金> 19,960,341円  
 コア資産形成ファンド 13,478,680円  
 MHAM TOP I XファンドVA (適格機関投資家専用) 692,612,483円  
 MHAM TOP I XファンドVA (適格機関投資家専用) 65,067,902円  
 MHAM動的パッケージファンド (適格機関投資家限定) 2,686,127,829円  
 MHAM日本株式バッシブファンド (適格機関投資家限定) 2,050,559,819円  
 期末元本合計 124,570,625,521円  
 担保資産 代用として担保を提供している資産はありません。

(注3)

## ■損益の状況

当期 自2021年2月9日 至2022年2月7日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	7,296,744,510円	
	受取配当金	7,292,821,896	
	受取利息	44,549	
	その他の収益	6,677,036	
	支払利息	△2,798,971	
(B)	有価証券売買損益	△7,496,155,473	
	売却益	39,449,298,775	
	売却損	△46,945,454,248	
(C)	先物取引等取引損益	654,522,360	
	取引益	1,686,367,190	
	取引損	△1,031,844,830	
(D)	当期損益金(A+B+C)	455,111,397	
(E)	前期繰越損益金	216,481,029,551	
(F)	解約差損益金	△309,165,756,529	
(G)	追加信託差損益金	364,995,605,514	
(H)	合計(D+E+F+G)	272,765,989,933	
	次期繰越損益金(H)	272,765,989,933	

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。